Nationalekonomiska institutionen

Stockholms universitet

Kursplan

för kurs på avancerad nivå

Ekonometri 4b: Empirisk makroekonomi **7.5 Högskolepoäng**

Econometrics 4b: Empirical Macroeconomics **7.5 ECTS credits**

Kurskod:	EC7415
Gäller från:	HT 2020
Fastställd:	2013-05-23
Ändrad:	2020-05-14
Institution	Nationalekonomiska institutionen
Ämne	Nationalekonomi
Fördjupning:	A1F - Avancerad nivå, har kurs/er på avancerad nivå som förkunskapskrav

Beslut

Denna kursplan är fastställd av Nationalekonomiska institutionens styrelse 23 maj 2013, och senast ändrad den 14 maj 2020.

Förkunskapskrav och andra villkor för tillträde till kursen

För tillträde till kursen krävs antingen (1) att studenten är antagen till masterprogram i nationalekonomi vid Stockholms universitet eller (2) har (a) behörighet för tillträde till masterprogram i nationalekonomi vid Stockholms universitet samt (b) har förkunskaper motsvarande de obligatoriska kurser som har getts innan denna kurs enligt den gällande utbildningsplanen för masterprogram i nationalekonomi.

Kursens uppläggning

Provkod	Benämning	Högskolepoäng
741A	Ekonometri 4b: Empirisk makroekonomi	7.5

Kursens innehåll

Kursen syftar till att ge studenterna ekonometriska verktyg för att besvara olika empiriska makroekonomiska frågeställningar. VAR, SVAR, kointegration, dynamiska paneler, GARCH, mikro till makro, Bayesianska VAR modeller samt enkla DSGE modeller behandlas. Fokus ligger på att applicera de olika metoderna på dataset och välja lämplig metod för olika frågeställningar. Bland de ekonomiska frågeställningar som diskuteras finns till exempel orsakerna till konjunkturcykelvariationer i BNP, långsiktiga makroekonomiska jämviktssamband, samt hur riskpremierna på makrofinansiella marknader bestäms. Den sista fjärdedelen av kursen ägnas åt hur makroekonomiska prognoser konstrueras och utvärderas.

Förväntade studieresultat

Studenten ska efter avslutad kurs:

• ha kunskap om och förståelse av centrala makroekonometriska metoder, särskilt multivariata tidsseriemetoder.

• kunna använda dessa metoder för att analysera relevanta frågeställningar.

• kunna avgöra vilken metod som är mest lämplig att använda för att analysera en makroekonomisk frågeställning.

• kunna producera och utvärdera makroekonomiska prognoser.

• kunna kritiskt utvärdera makroekonometriska analyser.

Undervisning
Undervisningen sker i form av föreläsningar och datorlaborationer. Undervisningsspråket är engelska.

Kunskapskontroll och examination
Kursen examineras genom inlämningsuppgifter och ett term paper.

Betygssättning sker enligt en sjugradig målrelaterad betygsskala: För godkänt resultat finns betygen A, B, C, D och E där A är högst och E är lägst. För underkänt resultat finns F och FX.

Betygskriterier:

• A: Studenten visar en utmärkt förståelse av teorin bakom de olika metoderna och deras tillämpning; Kan självständigt och med säkerhet använda metoderna för att analysera relevanta frågeställningar; Visar en utmärkt förståelse för vilka metoder som kan användas för att analysera olika frågeställningar.

• B: Studenten visar en mycket god förståelse av teorin bakom de olika metoderna och deras tillämpning; Kan självständigt använda metoderna för att analysera relevanta frågeställningar; Visar en mycket god förståelse för vilka metoder som kan användas för att analysera olika frågeställningar.

• C: Studenten visar en god förståelse av teorin bakom de olika metoderna och deras tillämpning; Kan använda metoderna för att analysera relevanta frågeställningar; Visar en grundläggande förståelse för vilka metoder som kan användas för att analysera olika frågeställningar.

• D: Studenten kan redogöra för de empiriska metoderna; Kan med vissa brister använda metoderna för att analysera relevanta frågeställningar; Visar viss förståelse för vilka metoder som kan användas för att analysera olika frågeställningar.

• E: Studenten kan redogöra för grundläggande empiriska metoder; Kan med påtagliga brister tillämpa metoderna för att analysera relevanta frågeställningar.

• FX: Studenten visar viss men otillräcklig teoretisk och empirisk kunskap.

• F: Studenten visar ingen påtaglig kännedom om kursens empiriska metoder.

För student som fått betyget FX eller F på ett prov finns inga restriktioner på hur många gångar man får genomgå prov för att uppnå lägst betyget E.

Övergångsbestämmelser
Om kursen upphör ges möjlighet att examineras på kursen vid tre tillfällen under tre terminer efter det att kursen upphör.

Övrigt
Kursen ingår även i huvudområdet ekonometri.

Utöver behörighetskraven för tillträde till kursen rekommenderas starkt att man har förkunskaper motsvarande kursen EC7413, Ekonometri 3b: Tidsseriedata, 7,5 hp.

Kurslitteratur
Se kurshemsidan via www.ne.su.se.